华宝兴业先进成长股票型证券投资基金

2010 第三季度报告

2010年9月30日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2010年10月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2010年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。 基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2010年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝兴业先进成长股票
基金主代码	240009
交易代码	240009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年11月7日
报告期末基金份额总额	1,182,489,497.05份
投资目标	分享我国经济增长方式转变过程中和转变完成后的先进企业的成长,在控制风险的前提下为基金份额持有人谋求长期超额回报。
投资策略	本基金将使用定量与定性相结合的方法,选择具备创新能力强、注重资源节约与环境友好、充分发挥人力资源优势这三个先进因素之一的企业进行投资,重点关注国家产业结构调整中鼓励类行业,同时也兼顾有先进企业的传统行业。
业绩比较基准	新上证综指收益率。
风险收益特征	本基金是一只积极型的股票投资基金,属于证券投资基金中的较高风险品种。
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2010年7月1日-2010年9月30日)
1.本期已实现收益	-178,263,049.10
2.本期利润	292,941,925.57
3.加权平均基金份额本期利润	0.2318
4.期末基金资产净值	2,494,404,461.51
5.期末基金份额净值	2.1095

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。 2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

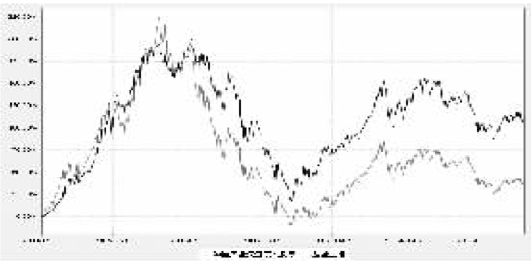
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去3个月	11.78%	1.20%	10.63%	1.18%	1.15%	0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华宝兴业先进成长股票型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2006年11月7日至2010年9月30日)



注:按照基金合同的约定,自基金成立日期的6个月内达到规定的资产组合,截至2007年5月7日,本基金已达到合同规定的资产配置比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴丰树	本基金基金经理	2009-5-14	-	7年	硕士,拥有CFA资格。2003年2月至2008年5月任中国国际金融有限公司研究部副总经理级研究员。2008年5月加入华宝兴业基金管理有限公司,同年9月至2009年12月任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理,2009年5月至今任华宝兴业先进成长股票型证券投资基金基金经理。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内,本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝兴业先进成长股票型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,基金管理人通过交易决策与交易执行相分离、交易部相对投资部门独立、每日交易日结报告等机制,确保所管理的各基金在交易中被公平对待。

本报告期内,基金管理人严格实施公平交易制度;加强了对所管理的不同投资组合同向交易价差的分析;分析结果没有发现交易价差异常。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期内,基金管理人管理的其他基金没有与本基金的投资风格相似的投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金没有发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

由于对后市始终保持乐观的态度,本基金在第三季度仍然保持了较高的股票仓位。然而,没有预料到的是第三季度市场的反弹小市值股票表现仍然比大市值股票出色。虽然本基金也参与了一些小市值股票的投资,但是对于基金整体净值的贡献有限。在行业配置的结构上,本基金仍然坚守了估值比较便宜的板块和大市值股票,这与市场比较仍存在不小的偏差。因此,整体上来讲,虽然看对了市场的反弹,但基金净值的表现不够理想。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期,基金净值上涨11.78%,表现好于比较基准。

4.4.3 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于经济基本面,国内外市场都处在复苏过程中,这点市场应该没有太大的分歧。就中国经济而言,保增长和调结构也将会是未来几年永恒的话题。只是,这两者在不同时间段被重视的程度会有所区别。不过,我们始终相信调结构必将以保增长为前提,因此对于中国经济增长速度不必过于担忧。从市场流动性方面来看,发达经济体不断采取数量化宽松措施来刺激经济增长短期内也很难改变,这会使得全球流动性充裕的格局短期不会变。像中国这样,经济保持良好增长的发展中经济体,更加会受到国际资本的青睐。巴西和印度股市已经回到金融危机前的高点就是最好的佐证。即使中国货币政策采取适当紧缩的措施,以控制不断攀升的通胀水平;但在当前国际形势下,特别是在房地产市场投资资金正在被政策驱赶出来的情况下,我们认为国内股票市场面临难得的资金充裕局面。况且,中国股票市场目前的整体估值水平还并不高。因此,我们对于市场仍保持乐观的态度,第四季度仍将保持高仓位运作,积极把握低估值板块的投资机会。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,206,147,422.47	86.42
	其中:股票	2,206,147,422.47	86.42
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	333,362,015.19	13.06
6	其他资产	13,266,453.38	0.52
7	合计	2,552,775,891.04	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	20,470,000.00	0.82
B	采掘业	155,537,834.96	6.24
C	制造业	885,153,783.88	35.49
C0	食品、饮料	64,408,615.07	2.58
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	21,000,000.00	0.84
C4	石油、化学、塑胶、塑料	107,318,696.03	4.30
C5	电子	40,726,798.70	1.63
C6	金属、非金属	325,258,141.19	13.04
C7	机械、设备、仪表	290,726,620.93	11.66
C8	医药、生物制品	35,714,911.96	1.43
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	21,192,000.00	0.85
E	建筑业	41,487,825.06	1.66
F	交通运输、仓储业	141,900,000.00	5.69
G	信息技术业	122,881,603.53	4.93
H	批发和零售贸易	101,278,342.25	4.06
I	金融、保险业	318,313,500.00	12.76
J	房地产业	273,604,040.84	10.97
K	社会服务业	59,582,811.63	2.39
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	64,745,680.32	2.60
	合计	2,206,147,422.47	88.44

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600761	安徽合力	7,999,893	127,438,295.49	5.11
2	600016	民生银行	20,000,000	102,000,000.00	4.09
3	600036	招商银行	7,000,000	90,650,000.00	3.63
4	000002	万 科A	10,000,000	84,000,000.00	3.37
5	600808	马钢股份	20,000,074	72,000,266.40	2.89
6	601318	中国平安	1,150,000	60,823,500.00	2.44
7	600050	中国联通	10,000,000	50,800,000.00	2.04
8	600115	东方航空	6,300,000	47,817,000.00	1.92
9	000898	鞍钢股份	5,500,000	45,540,000.00	1.83
10	002152	广电运通	1,000,000	43,500,000.00	1.74

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚,无证券投资决策程序需特别说明。

5.8.2 本基金股票投资的主要对象是先进企业股票,基金管理人建立有基金股票备选库。本报告期内本基金的前十名股票投资没有超出基金合同规定的股票备选库。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,567,533.64
2	应收证券清算款	11,305,399.91
3	应收股利	289,140.00
4	应收利息	62,520.57
5	应收申购款	41,859.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,266,453.38

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	1,301,835,436.72
本报告期基金总申购份额	14,170,029.86
减:本报告期基金总赎回份额	133,515,969.53
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	1,182,489,497.05

注:总申购份额含红利再投资和转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件;华宝兴业先进成长股票型证券投资基金基金合同;华宝兴业先进成长股票型证券投资基金招募说明书;华宝兴业先进成长股票型证券投资基金托管协议;基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程;基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告;基金托管人业务资格批件和营业执照。

7.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人住所备投资者查阅。

7.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站,查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝兴业基金管理有限公司
二〇一〇年十月二十六日

华宝兴业现金宝货币市场基金

2010 第三季度报告

2010年9月30日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2010年10月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2010年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2010年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝兴业现金宝货币	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2005年3月31日	
报告期末基金份额总额	1,416,948,781.40份	
投资目标	保持本金的安全性与流动性,追求高于比较基准的收益率。	
投资策略	以对宏观经济及利率走势的判断为基础,在满足组合平均久期、收益性以及信用等级的前提下利用现代金融分析方法和工具,优化组合配置效果,实现组合增值。	
业绩比较基准	同期7天通知存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种,其预期风险和预期收益率都低于股票、债券和混合型基金。	
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	华宝兴业现金宝货币A	华宝兴业现金宝货币B
下属两级基金的交易代码	240006	240007
报告期末下属两级基金的份额总额	160,092,948.43份	1,256,855,832.97份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2010年7月1日-2010年9月30日)	
	华宝兴业现金宝货币A	华宝兴业现金宝货币B
1.本期已实现收益	747,720.67	5,054,980.01
2.本期利润	747,720.67	5,054,980.01
3.期末基金资产净值	160,092,948.43	1,256,855,832.97

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1.华宝兴业现金宝货币A:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去3个月	0.4071%	0.0016%	0.3403%	0.0000%	0.0668%	0.0016%

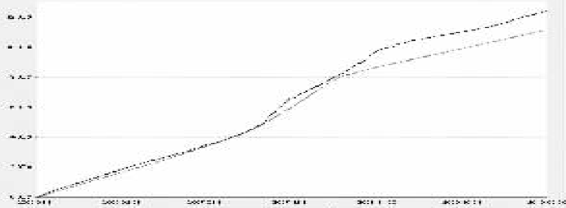
2.华宝兴业现金宝货币B:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去3个月	0.4681%	0.0016%	0.3403%	0.0000%	0.1278%	0.0016%

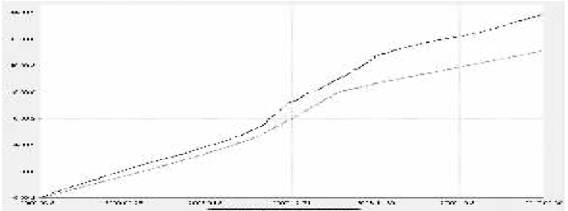
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华宝兴业现金宝货币市场基金
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2005年3月31日至2010年9月30日)

1、 华宝兴业现金宝货币A



2、 华宝兴业现金宝货币B



注:按照基金合同的约定,本基金自基金合同生效之日起不超过六个月内完成建仓。截至2005年4月7日,本基金已根据基金合同规定完成建仓。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
华志贵	本基金基金经理、华宝兴业增强收益债券基金经理	2010-6-26	-	6年	硕士。1999年7月至2000年8月在上海广电股份有限公司从事技术、市场工作,2004年5月至2008年7月在上海东方证券股份有限公司从事证券投资工作,2008年8月至2009年9月在中欧基金管理有限公司从事证券投资工作。2009年9月加入华宝兴业基金管理有限公司,任基金经理助理兼高级分析师,2010年6月至今任华宝兴业现金宝货币市场基金基金经理,2010年6月兼任华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金经理。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内,本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《货币市场基金管理暂行办法》、《华宝兴业现金宝货币市场基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,基金管理人通过交易决策与交易执行相分离、交易部相对投资部门独立、每日交易日结报告等机制,确保所管理的各基金在交易中被公平对待。

本报告期内,基金管理人严格实施公平交易制度;加强了对所管理的不同投资组合同向交易价差的分析;分析结果没有发现交易价差异常。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期内,基金管理人管理的其他基金没有与本基金的投资风格相似的投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金没有发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度初,伴随着年中时点因素影响的淡化,自5月下旬以来出现的流动性困局得到逐步缓解,货币市场利率水平呈现稳步回落态势,银行间7天回购利率重回1.7%附近。但至8月底开始,受工行转债发行以及临近中秋、国庆双节假期影响,机构纷纷未雨绸缪,市场流动性需求逐步升温,货币市场利率再度攀升,整个期间呈现U型走势。

报告期内,本基金基于对市场收益率走势的判断,降低了央票配置的比例,并相应地增加了融券回购以及存款投资比例,在有效规避利率风险的同时,获得了较为稳定的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

现金宝B:本基金报告期内净值增长率为0.4681%,同期业绩比较基准收益率为0.3403%。

现金宝A:本基金报告期内净值增长率为0.4071%,同期业绩比较基准收益率为0.3403%。

4.4.3 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,宏观经济仍将维持在景气水平,但通胀压力不容忽视。主要发达国家开启新一轮量化宽松,要素价格频创新高,人民币升值引发热钱流入,CPI居高不下都将强化市场的通胀预期,并对债券市场形成明显压制。尽管央行重申将继续实施适度宽松的货币政策,不过单就债券市场而言,2季度以来,流动性已略显趋紧,从资金价格走势可见一斑,价格中枢已逐步抬升,年底则可能再度出现阶段性的流动性紧张局面。央行公开市场操作动向值得关注,3M央票发行利率已于加息后上调20BP,但仍与二级市场存在明显倒挂,存在进一步靠拢的可能,如连续上调,短端收益率又将面临上行压力。

基于以上理由,本基金四季度将保持谨慎的策略,把流动性管理放在首位,积极把握收益率波动导致的阶段性投资机会,力求在控制风险的同时获取较好的投资回报。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	521,041,288.89	36.75
	其中:债券	521,041,288.89	36.75
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	468,301,382.45	33.03
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	422,258,284.36	29.78
4	其他资产	6,212,001.75	0.44
5	合计	1,417,812,957.45	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额		2.10
	其中:买断式回购融资		-
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的情况

报告期内债券正回购的资金余额没有超过基金资产净值20%的情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	65
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	96
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	53

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天的情况说明

本报告期内,本基金不存在投资组合平均剩余期限超过180天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	60.03	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	10.60	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	7.80	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	3.56	-
4	90天(含)—180天	7.07	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	14.13	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.62	-

5.4 报告期末按券种品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	220,674,179.83	15.57
	其中:政策性金融债	220,674,179.83	15.57
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	300,367,109.06	21.20
6	其他	-	-
7	合计	521,041,288.89	36.77
8	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	50,458,515.64	3.56

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1081044	10铁道CP01	900,000	90,146,912.95	6.36
2	1081252	10国电集CP03	800,000	80,086,889.82	5.65
3	060208	06国开08	600,000	60,201,624.55	4.25
4	1081095	10华侨城CP01	600,000	60,059,750.70	4.24
5	090223	09国开23	600,000	60,002,167.93	4.23
6	070211	07国开11	500,000	50,458,515.64	3.56
7	1081126	10中节能CP01	300,000	30,030,159.78	2.12
8	050413	05农发13	300,000	30,006,826.85	2.12
9	070417	07农发17	200,000	20,005,044.86	1.41
10	1081094	10五矿CP01	100,000	10,012,846.27	0.71

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项 目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.0530%
报告期内偏离度的最低值	-0.0392%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0340%

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按照票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在剩余期限内按实际利率法进行摊销,每日计提收益。

5.8.2 本报告期内,本基金不存在持有的剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况。

5.8.3 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	6,212,001.75
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	6,212,001.75

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	华宝兴业现金宝货币A	华宝兴业现金宝货币B
本报告期期初基金份额总额	219,760,475.74	1,381,564,290.66
本报告期基金总申购份额	213,693,619.15	1,148,282,043.63
减:本报告期基金总赎回份额	273,361,146.46	1,272,990,501.32
本报告期期末基金份额总额	160,092,948.43	1,256,855,832.97

注:总申购份额含份额级别调整和转换入份额;总赎回份额含份额级别调整和转换出份额。

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件;华宝兴业现金宝货币市场基金基金合同;华宝兴业现金宝货币市场基金招募说明书;华宝兴业现金宝货币市场基金托管协议;基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程;基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告;基金托管人业务资格批件和营业执照。

7.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

7.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站,查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝兴业基金管理有限公司
二〇一〇年十月二十六日

华宝兴业行业精选股票型证券投资基金

2010 第三季度报告

2010年9月30日

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2010年10月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2010年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2010年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝兴业行业精选股票
基金主代码	240010
交易代码	240010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年6月14日
报告期末基金份额总额	14,779,632,486.83份
投资目标	把握行业发展趋势和市场运行趋势,精选增长前景良好或周期复苏的行业和企业,在控制风险的前提下,追求基金净值的稳定增长和基金资产的长期增值。
投资策略	本基金将通过分析宏观经济、产业政策和行业景气程度,精选发展前景良好或景气程度向好的行业,通过行业估值模型与波特五力分析,加强对有吸引力行业的配置。在行业配置比例确定后,本基金将对基金管理人股票库相关精选行业的股票运用定量指标筛选排名靠前的股票,并进行定性分析,确定最终投资组合。
业绩比较基准	沪深300指数收益率。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的较高风险、较高收益的品种。
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2010年7月1日-2010年9月30日)
1.本期已实现收益	-1,420,439,236.61
2.本期利润	1,588,534,223.78
3.加权平均基金份额本期利润	0.1057
4.期末基金资产净值	13,971,763,374.73
5.期末基金份额净值	0.9453

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。 2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

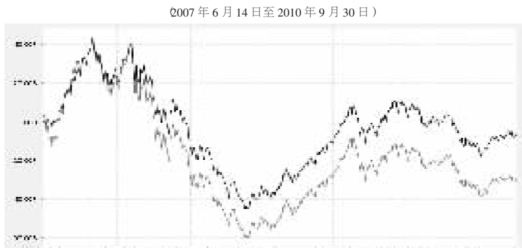
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去3个月	12.52%	1.11%	14.53%	1.31%	-2.01%	-0.20%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华宝兴业行业精选股票型证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2007年6月14日至2010年9月30日)



注:按照基金合同的约定,自基金成立日期的6个月内达到规定的资产组合,截至2007年12月14日,本基金已达到合同规定的资产配置比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
任志强	公司副总经理、投资总监、本基金基金经理	2007-9-7	-	13年	硕士。1995年3月至1997年3月就职于上海市外高桥保税区开发(控股)公司期货部;1997年4月至1999年2月任职于中国南方证券有限公司,从事证券研究工作。1999年3月至2006年10月在华宝信托投资有限责任公司工作,曾担任研究员、研发中心总经理助理、研发中心总经理、投资管理部总经理、公司总裁助理、公司董事会秘书等职务。2006年10月至2007年8月任华宝证券经纪有限公司董事、副总经理。2007年8月加入华宝兴业基金管理有限公司,任投资总监,2007年9月至今兼任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理,2009年6月任命为公司副总经理。
范红兵	本基金基金经理、华宝兴业大盘精选股票基金经理	2009-2-26	2010-9-4	10年	硕士。曾在南方证券股份有限公司、中新苏州工业园创业投资有限公司和平安证券股份有限公司从事证券研究、风险投资工作,于2007年7月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后任高级分析师、基金经理助理。2009年2月至2010年9月任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理,2010年7月至今任华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金经理。
蒋宁	本基金基金经理	2010-7-3	-	15年	硕士。1995年至1996年任职于上海万国证券公司证券投资总部从事证券研究工作,1996年至2010年3月任职于申银万国证券公司证券投资及金融衍生品总部从事证券投资、研究工作。2010年4月加入华宝兴业基金管理有限公司任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理助理,2010年7月至今任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理。
李靖	本基金基金经理	2010-9-4	-	10年	博士。1999年至2000年任和君创业投资有限公司研究员,2000年至2010年在光大证券有限公司先后任行业研究员、策略研究员、投资经理和定向理财部副总经理的职务。2010年7月加入华宝兴业基金管理有限公司任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理助理,2010年9月至今任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内,本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,基金管理人通过交易决策与交易执行相分离、交易部相对投资部门独立、每日交易日结报告等机制,确保所管理的各基金在交易中被公平对待。

本报告期内,基金管理人严格实施公平交易制度;加强了对所管理的不同投资组合同向交易价差的分析;分析结果没有发现交易价差异常。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期内,基金管理人管理的其他基金没有与本基金的投资风格相似的投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金没有发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年第三季度国内证券市场沪深指数呈现大幅反弹,涨幅排全球前列。在国内市场货币流动性宽松,负利率加剧,海外市场继续实施宽松的货币政策的情况下,市场对于中期中国经济二次探底的担忧逐渐消除,市场走出一轮强劲的反弹。前三季度市场对经济转型的预期强烈,市场也呈现了巨大的结构分化,中小板股票呈现结构性牛市,而以银行地产为代表的大市值股票则出现较大幅度的调整,整体估值中枢继续下移。

第三季度,本基金整体仓位上升,适度增持了汽车及零配件、建筑建材、食品饮料等行业,减持了部分银行、交通运输等行业股票。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金第三季度单位净值的增长率为12.52%,落后比较基准沪深300指数涨幅(14.53%)2.01个百分点。

4.4.3 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来的市场,我们认为短期由于美元下跌及日本降息因素刺激,市场对通胀及货币贬值预期加重,因此整体市场会继续追捧资源类品种,尤其在黄金、有色、煤炭、农产品等大宗商品上堆积更多的资金。短期看市场这些板块能继续能成为热点,而前期涨幅较大的小盘股,消费、医药等可能会做一定的调整,但这时候应该选择一些好的品种储备,在合适的价位介入,分享未来的成长。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	12,173,415,958.14	86.10
	其中:股票	12,173,415,958.14	86.10
2	固定收益投资	949,913.80	0.01
	其中:债券	949,913.80	0.01
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	1,956,614,343.05	13.84
6	其他资产	7,781,849.31	0.06
7	合计	14,138,762,064.30	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	39,138,059.82	0.28
B	采掘业	665,417,212.41	4.76
C	制造业	6,254,880,197.82	44.77
C0	食品、饮料	1,348,272,479.75	9.65
C1	纺织、服装、皮毛	94,270,010.08	0.67
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	588,389,676.70	4.21
C5	电子	317,042,586.36	2.27
C6	金属、非金属	1,033,689,720.23	7.40
C7	机械、设备、仪表	2,419,051,305.90	17.31
C8	医药、生物制品	355,042,578.75	2.54
C99	其他制造业	99,121,840.05	0.71
D	电力、煤气及水的生产和供应业	15,367,640.86	0.11
E	建筑业	1,021,495,625.15	7.31
F	交通运输、仓储业	155,263,732.22	1.11
G	信息技术业	363,500,979.61	2.60
H	批发和零售贸易	1,092,495,600.39	7.82
I	金融、保险业	1,681,605,588.85	12.04
J	房地产业	255,197,316.61	1.83
K	社会服务业	316,048,867.50	2.26
L	传播与文化产业	88,758,138.90	0.64
M	综合类	224,246,998.00	1.61
	合计	12,173,415,958.14	87.13

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	16,029,287	847,788,989.43	6.07
2	002024	苏宁电器	27,225,685	434,794,189.45	3.11
3	600036	招商银行	31,075,211	402,423,982.45	2.88
4	000858	五 粮 液	11,515,596	395,330,410.68	2.83
5	600104	上海汽车	22,973,827	387,108,984.95	2.77
6	600068	葛洲坝	34,942,311	303,998,105.70	2.18
7	600519	贵州茅台	1,719,245	290,088,208.85	2.08
8	600970	中材国际	7,538,151	269,036,609.19	1.93
9	600741	华域汽车	20,208,622	259,276,620.26	1.86
10	600547	山东黄金	4,569,781	255,313,664.47	1.83

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	949,913.80	0.01
7	其他	-	-
8	合计	949,913.80	0.01

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128233	塔牌转债	6,980	948,861.20	0.01
2	113001	中行转债	10	1,052.60	0.00
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚,无证券投资决策程序需特别说明。

5.8.2 本基金股票投资的主要对象是增长前景良好或周期复苏的行业和企业,基金管理人建立有基金股票备选库。本报告期内本基金的前十名股票投资没有超出基金合同规定的股票备选库。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,921,010.04
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	4,312,504.62
4	应收利息	441,078.78
5	应收申购款	107,255.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,781,849.31

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金在报告期末未持有处于转股期的可转换债券.

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	15,163,408,661.45
本报告期基金总申购份额	29,172,482.48
减:本报告期基金总赎回份额	412,948,657.10
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	14,779,632,486.83

注:总申购份额含红利再投资和转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件;华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金合同;华宝兴业行业精选股票型证券投资基金招募说明书;华宝兴业行业精选股票型证券投资基金托管协议;基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程;基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告;基金托管人业务资格批件和营业执照。

7.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

7.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站,查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝兴业基金管理有限公司
二〇一〇年十月二十六日